

**Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2006**  
**Fecha de Información: 27 de Septiembre de 2006**<sup>1</sup>

**INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$282,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,3	59,1	49,1	12,3	71,4
15-35	110,5	68,4	45,4	87,5	156,0
36-60	8,0	3,0	3,0	8,0	11,0
61-90	0,0	6,5	6,5	0,0	6,6
91-180	0,5	35,3	35,3	0,5	35,8
>180	0,0	1,5	1,5	0,0	1,5
<b>Total</b>	<b>141,4</b>	<b>173,8</b>	<b>140,8</b>	<b>108,4</b>	<b>282,2</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	3,4 %
15-35	3,0 %	3,0 %
36-60	3,6 %	3,5 %
61-90	3,5 %	3,4 %
91-180	3,3 %	3,2 %
>180	3,4 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,2 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	25 al 29 de Septiembre				2 al 6 de Octubre				9 al 13 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	12	20	1003	1014	170	19	536	461	30	16	474	423
<b>Real</b>	20	12	860	849	19	170	334	409	16	30	341	392
<b>Total</b>	33	33	1863	1863	190	190	870	870	46	46	816	816

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 28 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.